

长信量化多策略股票型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司，根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长信量化多策略股票	
场内简称	量化策略	
基金主代码	519965	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 7 月 14 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	74,144,720.88 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长信量化多策略股票 A	长信量化多策略股票 C
下属分级基金场内简称:	量化策略 A	量化策略 C
下属分级基金的交易代码:	519965	004858
报告期末下属分级基金的份额总额	73,953,053.49 份	191,667.39 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用数量化投资策略建立投资模型，将投资思想通过具体指标、参数的确定体现在模型中，在投资过程中充分发挥数量化投资纪律严格、投资视野宽阔、风险水平可控等优势，切实贯彻自上而下的资产配置和自下而上的个股精选的投资策略，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金和债券型基金，属于较高预期收益和较高预期风险的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	郭明
	联系电话	021-61009999	010-66105799
	电子邮箱	zhouyug@cxfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4007005566	95588
传真		021-61009800	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网	www.cxfund.com.cn
--------------------	-------------------

网址	
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 9 楼、 北京市西城区复兴门内大街 55 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	长信量化多策略股票 A	长信量化多策略股票 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	10,829,165.47	24,796.06
本期利润	17,145,402.09	41,779.98
加权平均基金份额本期利润	0.2143	0.2078
本期基金份额净值增长率	21.41%	20.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1228	-0.0495
期末基金资产净值	83,034,749.93	211,728.81
期末基金份额净值	1.123	1.105

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长信量化多策略股票 A

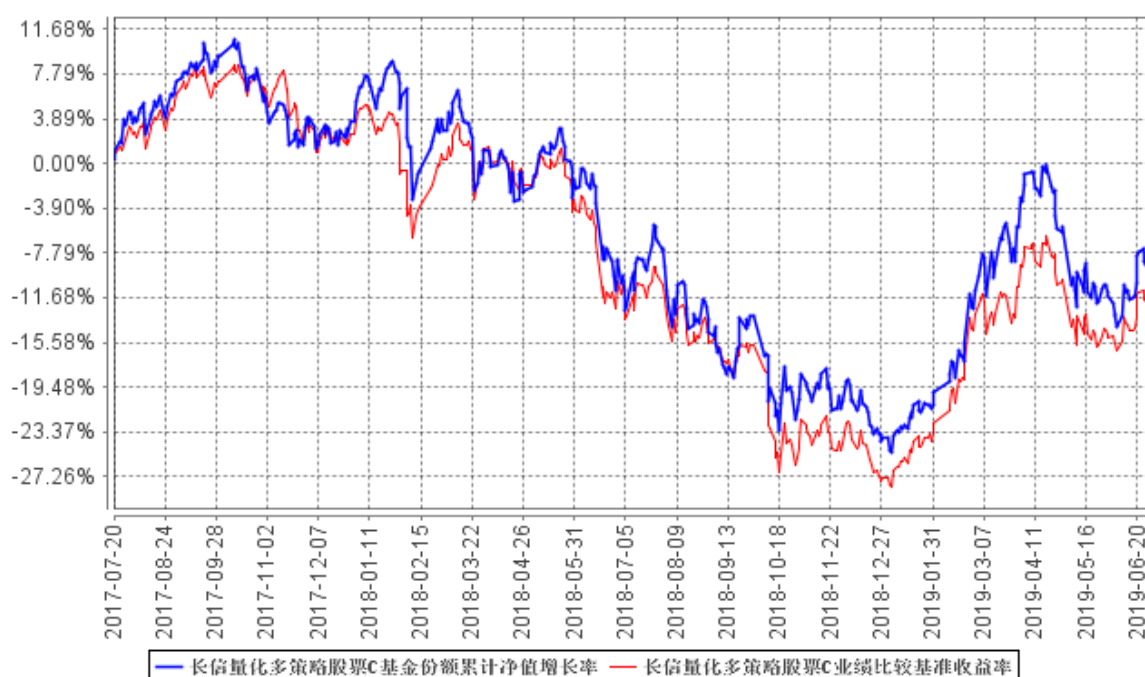
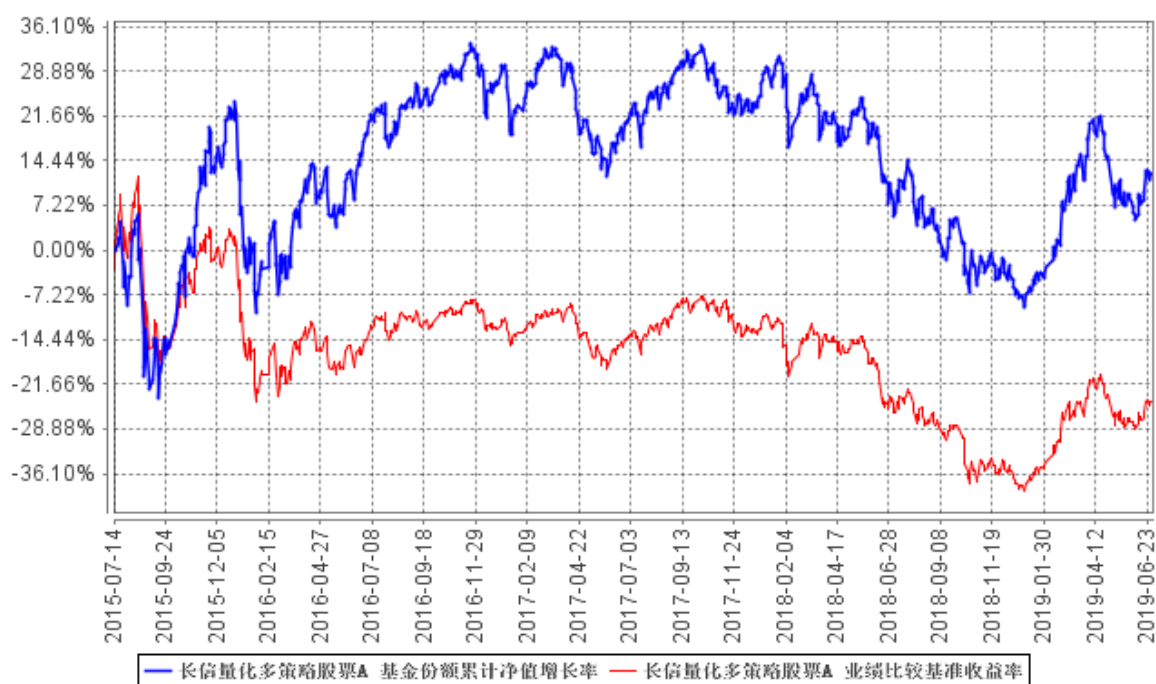
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.17%	1.16%	4.42%	0.93%	-0.25%	0.23%
过去三个月	-2.35%	1.44%	-0.72%	1.22%	-1.63%	0.22%
过去六个月	21.41%	1.44%	21.89%	1.24%	-0.48%	0.20%
过去一年	1.45%	1.43%	-1.16%	1.24%	2.61%	0.19%
过去三年	-5.63%	1.19%	-11.80%	1.00%	6.17%	0.19%
自基金合同生效起至今	12.30%	1.64%	-24.55%	1.40%	36.85%	0.24%

长信量化多策略股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	4.05%	1.18%	4.42%	0.93%	-0.37%	0.25%
过去三个月	-2.64%	1.44%	-0.72%	1.22%	-1.92%	0.22%
过去六个月	20.77%	1.44%	21.89%	1.24%	-1.12%	0.20%
过去一年	0.55%	1.44%	-1.16%	1.24%	1.71%	0.20%
自份额增加日起至今	-7.99%	1.27%	-11.38%	1.11%	3.39%	0.16%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、基金管理人自 2017 年 7 月 20 日起对长信量化多策略股票型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为 A 类份额，增设 C 类份额。

2、长信量化多策略股票 A 图示日期为 2015 年 7 月 14 日至 2019 年 6 月 30 日，长信量化多策略股票 C 图示日期为 2017 年 7 月 20 日（份额增加日）至 2019 年 6 月 30 日。

3、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63 号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本 1.65 亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 44.55%、上海海欣集团股份有限公司占 31.21%、武汉钢铁有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）占 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占 4.54%。

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 65 只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金 (LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型

发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金（FOF）、长信价值优选混合型证券投资基金、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信合利混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
左金保	长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长	2018 年 8 月 31 日	-	9 年	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业。2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，从事量化投资研究和风险绩效分析工作。历任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员、长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF）、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金和长信量化价值精选混合型证券投资基

	信量化价值驱动混合型证券投资基金和长信量化多策略股票型证券投资基金的基金经理、量化投资部总监兼量化研究部总监、投资决策委员会执行委员			金的基金经理。现任量化投资部兼量化研究部总监和投资决策委员会执行委员、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金和长信沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准；

2、本基金基金经理的证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形，未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年，社会融资超预期、实体利率走低、信用债利差收窄和 PMI 保持稳定等现象说明宏观经济预期正逐渐转暖，经济表现坚韧，同时微观与宏观流动性保持相对宽松。虽然中美贸易冲突未平又起，但持续恶化的可能也在逐步降低，而且美国经济逐渐疲弱也使得美联储议息会议偏鸽派。经历一季度大幅上涨，调整成为了二季度行情演绎的主旋律，股票市场的交易量保持在较高水平，指数盘整筑底，以中高端白酒和创新药为代表的消费白马股逆势走高。在极致的结构性行情下，分散投资的量化组合相对处于不利的局面本基金遵循量化投资，使用多因子模型综合考察全市场股票估值、成长、盈利等维度，严格遵照选股模型进行投资，追求长期稳健超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，长信量化多策略股票 A 基金份额净值为 1.123 元，份额累计净值为 1.123 元，份额净值增长率为 21.41%；截至本报告期末长信量化多策略股票 C 基金份额净值为 1.105 元，份额累计净值为 1.105 元，份额净值增长率为 20.77%；同期业绩比较基准收益率为 21.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，虽然国内外宏观经济环境依旧存在不确定性，但是随着国内财政政策与货币政

策的逐步落地，如减税降费政策和基建投资都将为中国经济注入新的活力。今年以来，经过一季度的上涨，估值得到一定程度的修复，在二季度调整之后，市场整体估值水平仍有吸引力。如果后续宏观经济与中观行业增长表现出韧劲，市场将打开业绩增长驱动的上漲空间。因此我们对 A 股持乐观的态度。我们将利用涵盖宏观、流动性、市场结构、交易特征等多个层面的模型，来监测市场可能存在的运行规律及发生的变动，从而捕捉市场中有效投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和估值程序，成立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，健全公司估值决策体系，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性及其适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成。相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法，均具备估值业务所需的专业胜任能力。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由与会估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过。对于估值政策和估值原则，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期没有进行利润分配。

本基金收益分配原则如下：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额的份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基

金份额的份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

- 4、同一类别每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对长信量化多策略股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，长信量化多策略股票型证券投资基金的管理人——长信基金管理有限责任公司在长信量化多策略股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对长信基金管理有限责任公司编制和披露的长信量化多策略股票型证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长信量化多策略股票型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	5,123,932.70	7,071,500.04
结算备付金	401,971.38	720,726.73
存出保证金	27,347.01	40,789.48
交易性金融资产	78,368,880.16	71,536,901.54
其中：股票投资	78,368,880.16	71,536,901.54
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,136.76	1,781.66
应收股利	-	-
应收申购款	16,905.45	18,708.15
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	83,940,173.46	79,390,407.60
负债和所有者权益	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	36,774.45	3,144.93
应付管理人报酬	100,185.02	103,092.00
应付托管费	16,697.50	17,182.01
应付销售服务费	168.58	178.22
应付交易费用	481,774.27	180,654.57
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	58,094.90	210,005.07
负债合计	693,694.72	514,256.80
所有者权益：		
实收基金	74,144,720.88	85,266,729.29
未分配利润	9,101,757.86	-6,390,578.49
所有者权益合计	83,246,478.74	78,876,150.80
负债和所有者权益总计	83,940,173.46	79,390,407.60

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，长信量化多策略股票 A 份额净值 1.123，长信量化多策略股票 C 份额净值 1.105，基金份额总额为 74,144,720.88 份，其中长信量化多策略股票 A 份额 73,953,053.49 份，长信量化多策略股票 C 份额为 191,667.39 份。

6.2 利润表

会计主体：长信量化多策略股票型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	18,575,980.98	-16,179,960.59
1.利息收入	25,002.59	91,197.88
其中：存款利息收入	25,002.59	91,197.88
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	12,203,962.86	29,692.70
其中：股票投资收益	11,536,874.37	-1,316,321.91
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	667,088.49	1,346,014.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6,333,220.54	-16,355,305.93
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	13,794.99	54,454.76
减：二、费用	1,388,798.91	2,392,990.38
1. 管理人报酬	639,111.70	1,290,059.28
2. 托管费	106,518.57	215,009.92
3. 销售服务费	1,053.11	1,057.04
4. 交易费用	583,775.02	762,551.81
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	58,340.51	124,312.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	17,187,182.07	-18,572,950.97
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	17,187,182.07	-18,572,950.97

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信量化多策略股票型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	85,266,729.29	-6,390,578.49	78,876,150.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,187,182.07	17,187,182.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-11,122,008.41	-1,694,845.72	-12,816,854.13
其中：1.基金申购款	4,991,532.85	374,210.99	5,365,743.84
2.基金赎回款	-16,113,541.26	-2,069,056.71	-18,182,597.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-	-

基金净值变动(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	74,144,720.88	9,101,757.86	83,246,478.74
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	161,133,973.80	39,860,761.66	200,994,735.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-18,572,950.97	-18,572,950.97
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-24,581,084.17	-6,618,298.56	-31,199,382.73
其中：1.基金申购款	10,462,614.42	2,283,896.17	12,746,510.59
2.基金赎回款	-35,043,698.59	-8,902,194.73	-43,945,893.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	136,552,889.63	14,669,512.13	151,222,401.76

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>成善栋</u>	<u>覃波</u>	<u>孙红辉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信量化多策略股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《长信量化多策略股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简

称“中国证监会”)以证监许可[2015]742号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为648,523,672.21份,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为毕马威华振验字第1500947号验资报告。基金合同于2015年7月14日生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据2017年7月17日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信量化多策略股票型证券投资基金增设C类基金份额相关事项的公告》,从2017年7月20日起,本基金增设C类份额(以下简称“长信量化多策略股票C”),长信量化多策略股票C的年销售服务率为1.00%。本基金分类后,原有基金份额将自动划归为本基金A类基金份额(以下简称“长信量化多策略股票A”),长信量化多策略股票A不收取销售服务费。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《长信量化多策略股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的比例不低于基金资产的80% - 95%;除股票外的其他资产占基金资产的比例为5% - 20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准自2018年10月22日起由原“中证500指数收益率 \times 80%+中证综合债券指数收益率 \times 20%”变更为“沪深300指数收益率 \times 80%+中证综合债券指数收益率 \times 20%”。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关

规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司	基金管理人、基金销售机构、C类基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.7.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.7.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.7.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应付关联方交易单元的佣金。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	639,111.70	1,290,059.28
其中：支付销售机构的客户维护费	294,320.28	413,028.74

注：支付基金管理人长信基金的基金管理费按前一日基金资产净值×1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	106,518.57	215,009.92

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.7.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信量化多策略股票 A	长信量化多策略股票 C	合计
长信基金	-	153.35	153.35
合计	-	153.35	153.35
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信量化多策略股票 A	长信量化多策略股票 C	合计

长信基金	-	104.83	104.83
合计	-	104.83	104.83

注：根据基金合同的规定，长信量化多策略股票 A 不收取销售服务费，长信量化多策略股票 C 的销售服务费按基金前一日基金资产净值×1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：长信量化多策略股票 C 的日销售服务费=前一日长信量化多策略股票 C 资产净值×1.00%÷当年天数。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	5,123,932.70	21,350.38	18,694,644.36	86,451.09

注：本基金用于证券交易结算的资金通过本基金托管人的基金托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2019年6月30日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2018年12月31日：同）

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入由关联方承销的证券。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.8 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购**

注：本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	78,368,880.16	93.36
	其中：股票	78,368,880.16	93.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,525,904.08	6.58
8	其他各项资产	45,389.22	0.05
9	合计	83,940,173.46	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,389,551.00	2.87
B	采矿业	952,720.55	1.14
C	制造业	34,907,494.77	41.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,330,028.00	4.00
E	建筑业	920,905.00	1.11
F	批发和零售业	1,577,082.00	1.89
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,163,008.00	1.40
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,692,588.48	4.44
J	金融业	27,159,808.36	32.63
K	房地产业	574,200.00	0.69

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,701,494.00	2.04
S	综合	-	-
	合计	78,368,880.16	94.14

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	63,822	5,655,267.42	6.79
2	601601	中国太保	73,300	2,676,183.00	3.21
3	000333	美的集团	50,700	2,629,302.00	3.16
4	601328	交通银行	360,000	2,203,200.00	2.65
5	600036	招商银行	60,000	2,158,800.00	2.59
6	601169	北京银行	329,200	1,945,572.00	2.34
7	000568	泸州老窖	23,300	1,883,339.00	2.26
8	601166	兴业银行	98,700	1,805,223.00	2.17
9	000157	中联重科	300,100	1,803,601.00	2.17
10	600837	海通证券	125,600	1,782,264.00	2.14

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于长信基金管理有限责任公司网站（www.cxfund.com.cn）的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601328	交通银行	4,672,106.00	5.92
2	601668	中国建筑	3,595,461.00	4.56
3	601117	中国化学	3,432,973.00	4.35

4	601288	农业银行	3,358,338.00	4.26
5	600637	东方明珠	3,203,498.27	4.06
6	601169	北京银行	3,112,055.25	3.95
7	601166	兴业银行	3,068,830.06	3.89
8	000338	潍柴动力	2,923,718.82	3.71
9	600606	绿地控股	2,825,340.84	3.58
10	601688	华泰证券	2,671,875.00	3.39
11	000333	美的集团	2,583,825.00	3.28
12	000709	河钢股份	2,497,345.00	3.17
13	600958	东方证券	2,494,004.00	3.16
14	002065	东华软件	2,452,883.96	3.11
15	600887	伊利股份	2,393,686.00	3.03
16	600339	中油工程	2,342,163.00	2.97
17	601377	兴业证券	2,239,121.00	2.84
18	000895	双汇发展	2,148,124.00	2.72
19	000568	泸州老窖	2,103,383.00	2.67
20	000630	铜陵有色	2,089,790.00	2.65
21	600999	招商证券	2,020,535.00	2.56
22	000423	东阿阿胶	2,006,986.00	2.54
23	600757	长江传媒	1,904,133.00	2.41
24	000719	中原传媒	1,895,695.00	2.40
25	002415	海康威视	1,888,481.00	2.39
26	601607	上海医药	1,860,982.00	2.36
27	600566	济川药业	1,841,087.00	2.33
28	601998	中信银行	1,821,668.00	2.31
29	603355	莱克电气	1,782,282.80	2.26
30	000425	徐工机械	1,747,479.00	2.22
31	601628	中国人寿	1,730,504.98	2.19
32	600809	山西汾酒	1,709,327.00	2.17
33	601939	建设银行	1,703,682.00	2.16
34	600837	海通证券	1,626,187.00	2.06
35	600271	航天信息	1,613,314.00	2.05
36	600351	亚宝药业	1,585,649.40	2.01

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	5,041,055.00	6.39
2	601211	国泰君安	3,530,913.00	4.48
3	601328	交通银行	3,439,240.46	4.36
4	601117	中国化学	3,337,669.00	4.23
5	601877	正泰电器	3,336,123.33	4.23
6	600390	五矿资本	3,202,022.98	4.06
7	000338	潍柴动力	3,117,253.30	3.95
8	601688	华泰证券	3,070,834.00	3.89
9	601988	中国银行	2,961,364.00	3.75
10	002674	兴业科技	2,953,127.00	3.74
11	601607	上海医药	2,947,260.95	3.74
12	601939	建设银行	2,929,251.00	3.71
13	601668	中国建筑	2,855,333.00	3.62
14	600606	绿地控股	2,794,412.95	3.54
15	000895	双汇发展	2,652,980.82	3.36
16	600887	伊利股份	2,573,372.00	3.26
17	600566	济川药业	2,522,471.35	3.20
18	600036	招商银行	2,469,019.62	3.13
19	600339	中油工程	2,403,807.00	3.05
20	000709	河钢股份	2,352,970.00	2.98
21	600031	三一重工	2,311,878.00	2.93
22	600999	招商证券	2,280,696.81	2.89
23	600886	国投电力	2,273,181.00	2.88
24	600637	东方明珠	2,245,230.65	2.85
25	603968	醋化股份	2,217,098.19	2.81
26	000568	泸州老窖	2,200,986.00	2.79
27	601818	光大银行	2,187,174.00	2.77
28	600373	中文传媒	2,155,219.14	2.73
29	603368	柳药股份	2,123,930.00	2.69
30	002146	荣盛发展	2,109,891.00	2.67
31	600383	金地集团	2,109,475.00	2.67
32	600351	亚宝药业	2,099,538.00	2.66
33	002415	海康威视	2,098,454.35	2.66
34	002475	立讯精密	2,061,127.00	2.61

35	601369	陕鼓动力	2,000,007.02	2.54
36	601336	新华保险	1,971,476.03	2.50
37	600028	中国石化	1,956,838.30	2.48
38	000423	东阿阿胶	1,949,209.59	2.47
39	300130	新国都	1,943,071.00	2.46
40	600660	福耀玻璃	1,884,408.00	2.39
41	600809	山西汾酒	1,851,361.00	2.35
42	000425	徐工机械	1,799,127.00	2.28
43	000719	中原传媒	1,798,539.00	2.28
44	002081	金螳螂	1,792,309.00	2.27
45	600977	中国电影	1,751,427.00	2.22
46	002737	葵花药业	1,748,550.00	2.22
47	603355	莱克电气	1,737,867.20	2.20
48	603886	元祖股份	1,732,775.00	2.20
49	000039	中集集团	1,732,438.40	2.20
50	002065	东华软件	1,669,056.00	2.12
51	601006	大秦铁路	1,667,845.33	2.11

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	229,945,944.46
卖出股票收入（成交）总额	240,984,060.75

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券中，交通银行于 2018 年 10 月 18 日受到中国保险监督管理委员会上海监管局作出的沪保监罚（2018）46 号处罚决定，经查，交通银行股份有限公司在 2016 年 1 月至 2017 年 6 月期间存在电销坐席欺骗投保人、向投保人隐瞒与合同有关的重要情况事项，违反了《中华人民共和国保险法》第一百三十一条的规定，根据该法第一百六十五条的规定，决定对公司处以罚款 34 万元的行政处罚，并责令改正违法行为。

对如上证券投资决策程序的说明：公司研究部门按照内部研究工作规范对该证券进行分析后将其列入基金投资对象备选库。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该事件发生后，本基金管理人对该证券的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未

对该证券投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该证券的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余九名的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	27,347.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,136.76
5	应收申购款	16,905.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,389.22

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长信量化多策略股票 A	3,945	18,746.02	0.00	0.00%	73,953,053.49	100.00%
长信量化多策略股票 C	11	17,424.31	0.00	0.00%	191,667.39	100.00%
合计	3,956	18,742.35	0.00	0.00%	74,144,720.88	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长信量化多策略股票 A	13,039.22	0.02%
	长信量化多策略股票 C	-	-
	合计	13,039.22	0.02%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	长信量化多策略股票 A	0
	长信量化多策略股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信量化多策略股票 A	0
	长信量化多策略股票 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信量化多策略股票 A	长信量化多策略股票 C
基金合同生效日（2015 年 7 月 14 日）基金份额总额	648,523,672.21	-
本报告期期初基金份额总额	85,050,421.13	216,308.16
本报告期期间基金总申购份额	4,983,795.59	7,737.26
减：本报告期期间基金总赎回份额	16,081,163.23	32,378.03
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	73,953,053.49	191,667.39

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内自 2019 年 3 月 2 日起，李小羽先生不再担任本基金管理人的副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人已在指定信息披露媒体发布相应公告。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘 会计师 事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人、托管人及其高级 管理 人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

国信证券（已 退租）	2	297,784,107.22	63.40%	158,209.55	52.54%	-
西南证券	1	171,910,878.12	36.60%	142,910.15	47.46%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	2	-	-	-	-	-
申银万国（已 退租）	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
国信证券（已 退租）	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
申银万国（已 退租）	-	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字【1998】29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

(1) 选择标准:

- 1) 券商基本面评价 (财务状况、经营状况);
- 2) 券商研究机构评价 (报告质量、及时性和数量);
- 3) 券商每日信息评价 (及时性和有效性);
- 4) 券商协作表现评价。

(2) 选择程序:

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

长信基金管理有限责任公司

2019 年 8 月 27 日